

附件

## 《大连商品交易所风险管理办法》修正案

第十五条 当交易所上市的商品期货合约在某一交易日（该交易日记为第 N 个交易日，之后第 1 个、第 2 个、第 3 个交易日分别记为第 N+1、第 N+2、第 N+3 个交易日，以此类推）出现涨跌停板单边无连续报价的情况，~~则当日结算时起，该合约的交易保证金按合约价值的 8% 收取。第 N+1 个交易日该合约的涨跌停板幅度为 6%。~~则该合约第 N+1 个交易日涨跌停板幅度在第 N 个交易日涨跌停板幅度的基础上增加 3 个百分点（例，如果第 N 个交易日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的 4%，则第 N+1 个交易日涨跌停板幅度则为第 N 个交易日结算价的 7%，下同）。第 N 个交易日结算时，该合约交易保证金标准为在第 N+1 个交易日涨跌停板幅度的基础上增加 2 个百分点（例，如果第 N+1 个交易日涨跌停板幅度为第 N 个交易日结算价的 7%，则第 N 个交易日结算时，该合约保证金标准为合约价值的 9%，下同）。若该合约调整后的交易保证金标准低于第 N 个交易日前一交易日结算时的交易保证金标准，则按第 N 个交易日前一交易日结算时该合约交易保证金标准收取；若第 N 个交易日为该合约上市挂盘后第 1 个交易日，则该合约上市挂盘当日

交易保证金标准视为该合约第 N 个交易日前一交易日结算时的交易保证金标准。

~~第十六条~~若第 N+1 个交易日出现与第 N 个交易日同方向涨跌停板单边无连续报价的情况，~~则第 N+1 个交易日结算时起，该合约的交易保证金按合约价值的 10% 收取。第 N+2 个交易日该合约的涨跌停板幅度为 8%。~~则该合约第 N+2 个交易日涨跌停板幅度在第 N+1 个交易日涨跌停板幅度的基础上增加 2 个百分点。第 N+1 个交易日结算时，该合约交易保证金标准为在第 N+2 个交易日涨跌停板幅度的基础上增加 2 个百分点。若该合约调整后的交易保证金标准低于第 N 个交易日结算时的交易保证金标准，则按第 N 个交易日结算时该合约的交易保证金标准收取。

若第 N+2 个及以后交易日出现与第 N+1 个交易日同方向涨跌停板单边无连续报价情况，则从第 N+3 个交易日开始，涨跌停板幅度和交易保证金标准与第 N+2 个交易日一致，直至合约不再出现同方向涨跌停板单边无连续报价的情况。

第十六条 当第 N+1 个及以后交易日出现与前一交易日反方向涨跌停板单边无连续报价的情况，则该交易日视为第 N 个交易日。

第十七条 当第 N+1 个及以后交易日未出现涨跌停板单边无连续报价的情况，则该交易日结算时交易保证金恢复到正常水平，下一交易日的涨跌停板幅度恢复到正常水平。

~~第十八条 若某期货合约在某交易日未出现与上一交易日同方向涨跌停板单边无连续报价的情况，则该交易日结算时交易保证金恢复到正常水平，下一交易日该合约的涨跌停板幅度恢复到正常水平。~~

第十九条 .....

~~（七）强制减仓当日结算时交易保证金恢复到正常水平，下一交易日该合约的涨跌停板幅度按合约规定执行。~~

.....

注：阴影部分为新增内容，双划线部分为删除内容，“.....”（省略号）含义为该条款未修改的其他内容；出现条款增删的，其他条款顺序依次顺延。